

**Fecha de Publicación: 8 de noviembre de 2016**

**Fecha de Información: 03 de noviembre de jueves <sup>1</sup>**

## **INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS**

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$2020.4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5.9%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
**Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragruo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	313.2	375.1	216.0	127.8	15.6	42.0	143.5
15-35	665.4	551.9	326.1	286.0	12.8	166.4	213.0
36-60	70.5	58.1	0.0	0.0	58.1	70.5	0.0
61-90	92.3	32.3	15.0	10.0	7.3	72.3	10.0
91-180	53.8	63.8	0.0	0.0	41.8	31.8	22.0
>180	47.1	111.4	85.0	10.0	0.4	11.1	26.0
<b>Total</b>	<b>1242.3</b>	<b>1192.6</b>	<b>642.1</b>	<b>433.8</b>	<b>136.0</b>	<b>394.1</b>	<b>414.5</b>

\* Cifras en millones de dólares

\*\*Incluye operaciones interbancarias y operaciones con los otros agentes

\*\*\*Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

**Cuadro No. 2**

### **Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada**

Rango	Sector Financiero*	Otros Agentes sin intragruo		Total
		Compras	Ventas	
3-14	6.5 %	6.4 %	3.3 %	5.6 %
15-35	6.5 %	6.5 %	6.2 %	6.4 %
36-60	-	5.7 %	5.7 %	5.7 %
61-90	5.1 %	5.8 %	5.4 %	5.5 %
91-180	5.4 %	5.6 %	5.4 %	5.5 %
>180	5.7 %	5.6 %	5.3 %	5.6 %
<b>Total</b>	<b>6.4 %</b>	<b>6.2 %</b>	<b>5.5 %</b>	<b>5.9 %</b>

\*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

<sup>1</sup> Datos provisionales.

<sup>2</sup> El monto negociado diario corresponde a las operaciones de compra y venta evitando la doble contabilización de las operaciones interbancarias. Además, la fórmula para la devaluación implícita es:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{\frac{1}{360/\text{Plazo}}}) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruo.

**Cuadro No. 3**  
**Vencimientos de Forwards**

Sectores	31 de oct. al 4 de noviembre				7 al 11 de noviembre				14 al 18 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	35	101	4375	3567	38	80	2533	2489	36	84	2193	2058
<b>Intragrupo y off-shore***</b>	0	0	1644	2041	0	0	1140	875	0	0	1044	948
<b>Otros</b>	101	35	849	1261	80	38	750	1059	84	36	649	879
<b>Total</b>	<b>136</b>	<b>136</b>	<b>6868</b>	<b>6868</b>	<b>118</b>	<b>118</b>	<b>4423</b>	<b>4423</b>	<b>121</b>	<b>121</b>	<b>3886</b>	<b>3886</b>

\* Cifras en millones de dólares; No incluye operaciones aceptadas por Cámaras de Riesgo Central de Contraparte.

\*\*Incluye operaciones interbancarias y con otros agentes

\*\*\*Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.